

DAILY SIGNAL

上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年8月27日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

	8月21日	8月22日	8月23日	8月24日
加重平均金利	▲0.063	▲0.061	▲0.055	▲0.053
東京レポレート(ON)	▲0.099	▲0.101	▲0.104	▲0.125
無コール残	72,136	75,387	75,382	80,530
ON	45,061	48,102	47,097	51,485
その他	27,075	27,285	28,285	29,045
有コール残	22,468	19,004	16,135	13,493

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

8月28日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
8:50 製造業部門別投入・産出物価指数(7月)	-	23:00 (米)8月消費者信頼感指数	126.5
14:00 基調的なインフレ率を捕捉するための指標	-	-	-
-	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.080	0.003	▲0.054	▲0.122
T/N	-	-	0.000	▲0.146
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.033	0.001	▲0.023	▲0.149
2W	▲0.050	▲0.005	▲0.024	▲0.142
3W	-	-	-	▲0.141
1M	-	-	▲0.010	▲0.141
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.142
6M	-	-	-	▲0.149
1Y	-	-	-	▲0.159

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

本日の市況

本日の無担保コールON物は、▲0.06%の出合から始まった。その後は主に▲0.08~▲0.025%の水準で取引された。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.054%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.080 ~ ▲0.080	▲0.060 ~ ▲0.060	▲0.080 ~ ▲0.025

翌営業日のマーケット

引き続き、地銀業態を中心に調達ニーズが底堅い展開を予想する。

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月27日	8月28日	8月27日	8月28日	8月29日	8月29日
券		+400		▲200		+0
財政		+4,500		+1,800		▲5,000
過不足		+4,900		+1,600		▲5,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入				+2,500		
国債買入		+9,600				
共通担保(全店)	▲2,200	+2,200				
CP等買入	▲300		▲500			
社債等買入		+800				
国債補完供給	+400	▲1,300	+1,300			
当座預金増減		+14,100		+4,900		▲5,000
当座預金残高		3,930,900		3,935,800		3,930,800
準備預金残高		3,434,800	主な需給要因			
積み終了先		3,434,100				
超過準備		3,434,100				
非準備預金残高		496,100				
準備預金進捗率		99.7%				
平均		38.7%				
乖離率		61.0%				

8月27日のオペ結果 [%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$
オペ種類 オファー 応札 落札 足切 平均 接分

国庫短期証券買入(8/28~)	2,500	8,826	2,503	▲0.005	▲0.004	40.1
国債補完供給(8/27~8/28)	40,000	1,327	1,327	▲0.600	▲0.600	

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
8月24日時点 5,011,600	今積期の所要準備額 3,120,700
	8月28日以降の残り所要積数 8,100
	平均 400

国庫短期証券入札予定

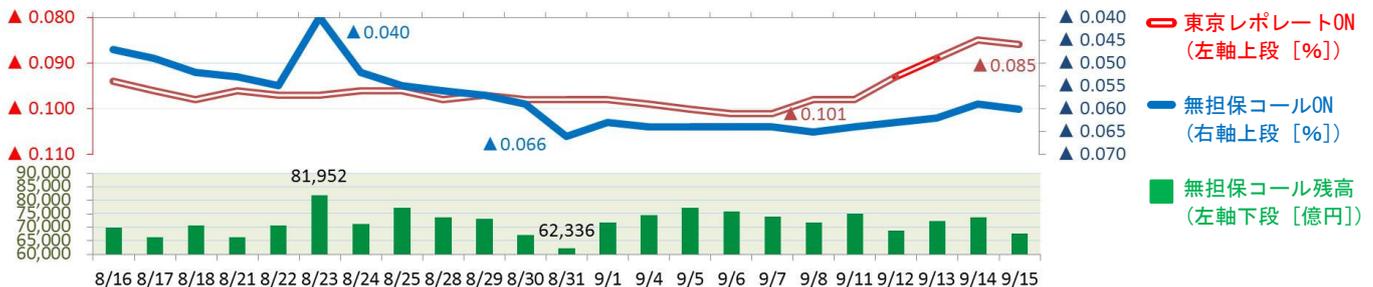
8月31日	3ヶ月	第780回
9月6日	6ヶ月	
9月7日	3ヶ月	
9月14日	3ヶ月	
国債入札予定		
8月30日	2年	
9月5日	10年	
9月11日	30年	
9月13日	5年	

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	8月1日	1
1年超3年以下	2,000~3,000 程度	2,500			
3年超5年以下	2,500~3,500 程度	3,000	1 8 10 17 24	31	8月24日 1
5年超10年以下	3,000~5,000 程度	4,000	3 8 15 22 24	31	8月24日 1
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	500~1,500 程度	600	3 10 15 22 29		8月22日 1
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	8月22日	0
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	8月17日	0

1年前の市場推移

○2017年8月積み期 [8月16日~9月15日] ※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。

上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登号)第243号 加入協会 日本証券業協会